

# 融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>43</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	融通巨潮 100 指数 (LOF)
场内简称	融通巨潮
基金主代码	161607
前端交易代码	161607
后端交易代码	161657
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2005 年 5 月 12 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	814,592,289.06 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 6 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上, 力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益, 追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果, 实现基金财产的长期增长, 为投资者带来稳定的回报。
投资策略	基金以指数化分散投资为主要投资策略, 在此基础上进行适度的主动调整, 在量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险, 本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%。
业绩比较基准	巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	洪渊
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798

注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518053	100140
法定代表人	高峰	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处，深圳证券交易所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-71,751,507.59
本期利润	-116,384,985.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1405
本期加权平均净值利润率	-15.09%
本期基金份额净值增长率	-12.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-92,692,307.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1138
期末基金资产净值	771,181,914.98
期末基金份额净值	0.947
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	215.41%

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

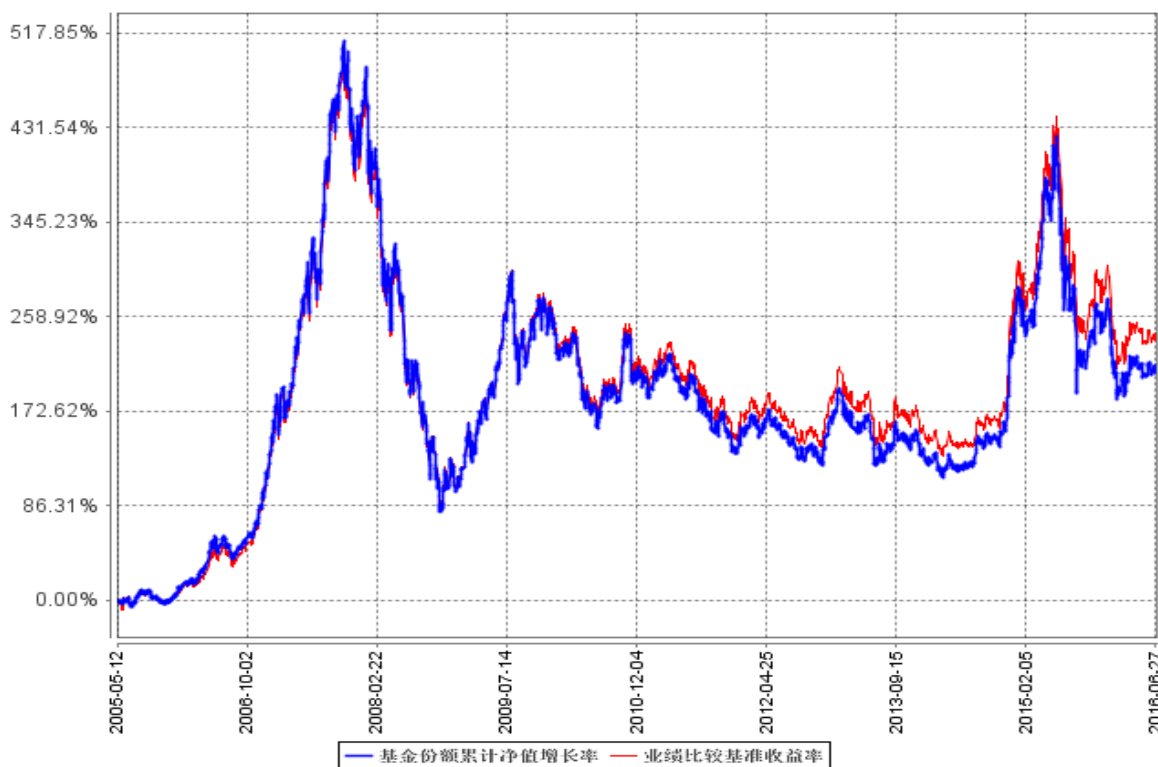
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.32%	0.87%	-0.80%	0.78%	0.48%	0.09%
过去三个月	-1.15%	0.89%	-1.69%	0.82%	0.54%	0.07%
过去六个月	-12.96%	1.72%	-12.44%	1.60%	-0.52%	0.12%
过去一年	-26.42%	2.19%	-25.59%	2.08%	-0.83%	0.11%
过去三年	37.65%	1.82%	38.78%	1.74%	-1.13%	0.08%
自基金合同生效起至今	215.41%	1.88%	243.68%	1.77%	-28.27%	0.11%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于

2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 40%。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；四十四只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金 (LOF)、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金 (LOF)、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法 (QDII-FOF) 基金、融通汇财宝货币市场基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇	融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理	2015 年 1 月 9 日	-	11	李勇先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士，11 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2005 年 1 月入职融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。2010 年 11 月 15 日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”基金经理，2012 年 4 月 6 日起至今任“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理，2015 年 1 月 9 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理。
蔡志伟	融通巨潮 100 指数证券投资	2015 年 2 月	-	4	蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士，金融风险管



	基金 (LOF) 的 基金经理	11 日			理师 (FRM), 4 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司, 历任风险管理专员、金融工程研究员, 2015 年 2 月 11 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理。
--	--------------------	------	--	--	--

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日, 首任基金经理, 任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 无损害基金持有人利益的行为, 本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则, 在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下 (日内、3 日内、5 日内) 公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析, 各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内, 本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想, 并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式, 通过控制股票投资权重与巨潮 100 指数成份股自然权重的偏离, 减少基金相对巨潮 100 指数基金基准的跟踪误差, 力求最终实现对巨潮 100 指数基金基准的有效跟踪。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为-12.96%，基金业绩比较基准收益率为-12.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，中国宏观经济基本面总体偏稳，货币流动性总体稳健，而供给侧改革持续发力。中国经济在经历了一段时间的下行周期后，目前进入深度去产能阶段。体现在：投资增速总体趋缓，三驾马车推动乏力；消费疲弱；外需环境改善幅度有限。预计 3-6 个月的短周期经济或将呈现 L 型底部状态，三季度前通胀相对温和，四季度或为全年高点。

从全球经济的角度看，2016 年全球经济依然疲软，美国 GDP 增速在 2015 年开始已经缓慢走弱，就业结构恶化、新增就业不佳；同时美联储加息次数减少、加息时间一再延后，意味着宽松货币政策再度延长，也侧面印证美国经济复苏仍不稳定。

中国当前的宏观环境处于 GDP 增速连续几年回落、企业产能过剩、杠杆高企的境遇下。随着改革的推进，我们认为经济将走出“L”形，未来可以期待智能制造等新兴产业的发展壮大，从而推动经济从“L”形向“U”形转变。

在此宏观背景下，展望下半年 A 股市场，我们认为市场将进入震荡阶段，存量博弈。震荡市业绩为王，优质成长股与高景气度行业将是战略性配置品种，高成长股可做战术性配置。具体来看，看好白马成长类代表性行业如食品饮料、家电等；从高景气度行业里精选，如禽养殖链，以及代表智能制造的新能源、智能汽车产业链，代表新兴消费的体育娱乐等；从供给侧改革角度精选供给收缩，库存下降，产品持续涨价的资源品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以

及估值政策和程序进行评价, 金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核, 登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值, 每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总, 供估值委员会参考, 监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定, 参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突, 截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配, 符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)2016年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体: 融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,818,868.20	45,886,950.75
结算备付金		1,456,891.81	1,398,521.53
存出保证金		132,082.70	230,945.69
交易性金融资产	6.4.7.2	761,118,287.19	853,708,582.34
其中：股票投资		731,124,287.19	853,708,582.34
基金投资		-	-
债券投资		29,994,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,225,655.10	-
应收利息	6.4.7.5	360,589.10	10,021.05
应收股利		-	-
应收申购款		5,589.49	71,843.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		774,117,963.59	901,306,864.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		623,069.46	1,748,369.60
应付管理人报酬		816,406.58	996,110.62
应付托管费		125,601.03	153,247.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	894,021.33	523,843.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	476,950.21	348,396.07
负债合计		2,936,048.61	3,769,967.27
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	814,592,289.06	825,119,992.48
未分配利润	6.4.7.10	-43,410,374.08	72,416,904.69
所有者权益合计		771,181,914.98	897,536,897.17
负债和所有者权益总计		774,117,963.59	901,306,864.44

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.947 元，基金份额总额 814,592,289.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-107,005,194.33	407,392,187.82
1. 利息收入		342,675.82	1,244,343.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	93,651.23	328,417.62
债券利息收入		249,024.59	915,926.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-62,761,433.32	606,182,686.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-69,869,487.17	593,090,872.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-2,960.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,108,053.85	13,094,773.95
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-44,633,478.02	-201,103,242.32
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	47,041.19	1,068,399.79
<b>减：二、费用</b>		9,379,791.28	22,969,113.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,990,769.22	14,523,064.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	767,810.69	2,234,317.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,385,552.25	5,926,140.30
5. 利息支出		-	946.92
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	235,659.12	284,644.11
<b>三、利润总额</b>		-116,384,985.61	384,423,074.58
减：所得税费用		-	-

四、净利润		-116,384,985.61	384,423,074.58
-------	--	-----------------	----------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	825,119,992.48	72,416,904.69	897,536,897.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-116,384,985.61	-116,384,985.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,527,703.42	557,706.84	-9,969,996.58
其中：1. 基金申购款	51,022,313.71	-4,192,041.14	46,830,272.57
2. 基金赎回款	-61,550,017.13	4,749,747.98	-56,800,269.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	814,592,289.06	-43,410,374.08	771,181,914.98
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,061,299,663.26	256,548,133.02	2,317,847,796.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	384,423,074.58	384,423,074.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-938,675,652.01	-319,136,960.05	-1,257,812,612.06
其中：1. 基金申购款	665,836,911.06	105,892,480.54	771,729,391.60
2. 基金赎回款	-1,604,512,563.07	-425,029,440.59	-2,029,542,003.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	1,122,624,011.25	321,834,247.55	1,444,458,258.80
-----------------	------------------	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孟朝霞</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 18 号《关于同意融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 513,273,618.60 元,认购资金产生的利息折份额为 253,579.83 份基金份额,基金合同生效日基金份额总额为 513,527,198.43 份,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 65 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》于 2005 年 5 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 513,527,198.43 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第(56)号文审核同意,本基金 188,512,868.00 份基金份额于 2005 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为增强型指数基金,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票,包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票,本基金还可适当投资一级市场的股票(包括新股与增发)。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10%以内,但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%以内。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%,保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩

比较基准为：巨潮 100 指数收益率  $\times$  95% + 银行同业存款利率  $\times$  5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。



(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,818,868.20
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	9,818,868.20

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	729,293,442.10	731,124,287.19	1,830,845.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	30,007,800.00	29,994,000.00	-13,800.00
	合计	30,007,800.00	29,994,000.00	-13,800.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	759,301,242.10	761,118,287.19	1,817,045.09	

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末买入返售金融资产余额均为零。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,593.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	590.04
应收债券利息	358,352.46
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	53.55
合计	360,589.10

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	894,021.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	894,021.33

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	695.09
其他应付款	250,000.00
预提费用	226,255.12
应付后端申购费	-
合计	476,950.21

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	825,119,992.48	825,119,992.48
本期申购	51,022,313.71	51,022,313.71
本期赎回	-61,550,017.13	-61,550,017.13
本期末	814,592,289.06	814,592,289.06

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,611,733.12	97,028,637.81	72,416,904.69
本期利润	-71,751,507.59	-44,633,478.02	-116,384,985.61
本期基金份额交易产生的变动数	3,670,933.28	-3,113,226.44	557,706.84
其中：基金申购款	-2,693,217.45	-1,498,823.69	-4,192,041.14
基金赎回款	6,364,150.73	-1,614,402.75	4,749,747.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-92,692,307.43	49,281,933.35	-43,410,374.08

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	77,142.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,845.04
其他	2,663.62
合计	93,651.23

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,121,612,079.67
减: 卖出股票成本总额	1,191,481,566.84
买卖股票差价收入	-69,869,487.17

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,108,053.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,108,053.85

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-44,633,478.02
——股票投资	-44,619,678.02
——债券投资	-13,800.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-44,633,478.02

#### 6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	46,809.32
转入费收入	231.87

其他	-
印花税返还	-
合计	47,041.19

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,385,327.25
银行间市场交易费用	225.00
合计	3,385,552.25

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	47,239.92
信息披露费	149,179.94
上市费	29,835.26
银行费用	404.00
债券帐户维护费	9,000.00
合计	235,659.12

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
新时代证券	1,566,527,815.03	70.19%	2,662,077,446.01	76.01%

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	1,458,769.25	70.62%	628,427.64	70.29%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	2,423,551.16	76.40%	991,705.61	81.57%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,990,769.22
其中：支付销售机构的客户维护费	973,852.68	2,234,303.43

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.3% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	767,810.69		2,234,317.57	

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	9,818,868.20	77,142.57	70,487,445.94	283,424.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1. 本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2. 本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	6,026	78,217.48	78,217.48	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600019	宝钢	2016	重大资	4.90	-	-	2,934,520	16,023,951.60	14,379,148.00	-



	股份	年 6 月 27 日	产重组							
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	503,640	6,253,175.94	9,166,248.00	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	22.07	-	-	190,674	2,058,531.98	4,208,175.18	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	24,663	804,777.70	412,365.36	-
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	股价异常波动	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	2,016	6,995.52	42,174.72	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金。本基金主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损

失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

**6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资**

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日
AAA	29,994,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
<b>合计</b>	<b>29,994,000.00</b>

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

## 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,818,868.20	-	-	-	9,818,868.20
结算备付金	1,456,891.81	-	-	-	1,456,891.81
存出保证金	132,082.70	-	-	-	132,082.70
交易性金融资产	29,994,000.00	-	-	731,124,287.19	761,118,287.19
应收证券清算款	-	-	-	1,225,655.10	1,225,655.10
应收利息	-	-	-	360,589.10	360,589.10
应收申购款	-	-	-	5,589.49	5,589.49
资产总计	41,401,842.71	-	-	732,716,120.88	774,117,963.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	623,069.46	623,069.46
应付管理人报酬	-	-	-	816,406.58	816,406.58
应付托管费	-	-	-	125,601.03	125,601.03
应付交易费用	-	-	-	894,021.33	894,021.33
其他负债	-	-	-	476,950.21	476,950.21
负债总计	-	-	-	2,936,048.61	2,936,048.61
利率敏感度缺口	41,401,842.71	-	-	729,780,072.27	771,181,914.98
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,886,950.75	-	-	-	45,886,950.75
结算备付金	1,398,521.53	-	-	-	1,398,521.53
存出保证金	230,945.69	-	-	-	230,945.69
交易性金融资产	-	-	-	853,708,582.34	853,708,582.34

应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,021.05	10,021.05
应收申购款	-	-	-	71,843.08	71,843.08
资产总计	47,516,417.97	-	-	853,790,446.47	901,306,864.44
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,748,369.60	1,748,369.60
应付管理人报酬	-	-	-	996,110.62	996,110.62
应付托管费	-	-	-	153,247.77	153,247.77
应付交易费用	-	-	-	523,843.21	523,843.21
其他负债	-	-	-	348,396.07	348,396.07
负债总计	-	-	-	3,769,967.27	3,769,967.27
利率敏感度缺口	47,516,417.97	-	-	850,020,479.20	897,536,897.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.89%（2015 年 6 月 30 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 6 月 30 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估，定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门及时进行投资组合的调整。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%；保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例

合计不低于基金资产净值的 5%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	731,124,287.19	94.81	853,708,582.34	95.12
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	29,994,000.00	3.89	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	761,118,287.19	98.70	853,708,582.34	95.12

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除巨潮 100 指数外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	巨潮 100 指数上升 5%	39,213,594.20	111,256,694.22
	巨潮 100 指数下降 5%	-39,213,594.20	-111,256,694.22

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	731,124,287.19	94.45
	其中: 股票	731,124,287.19	94.45
2	固定收益投资	29,994,000.00	3.87
	其中: 债券	29,994,000.00	3.87
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,275,760.01	1.46
7	其他各项资产	1,723,916.39	0.22
8	合计	774,117,963.59	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,459,666.00	0.19
B	采矿业	34,896,190.56	4.53
C	制造业	171,219,282.28	22.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,340,145.99	0.95
E	建筑业	26,694,698.29	3.46
F	批发和零售业	4,256,100.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,721,359.12	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,308,624.20	3.28
J	金融业	368,286,630.47	47.76
K	房地产业	36,010,285.66	4.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	475,782.06	0.06
S	综合	-	-
	合计	677,668,764.63	87.87

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,020,293.50	1.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,406,280.88	1.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	42,174.72	0.01
F	批发和零售业	3,732,660.00	0.48

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.01
J	金融业	18,825,064.30	2.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,154,612.46	0.93
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	3,183,818.20	0.41
	合计	53,455,522.56	6.93

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,476,934	47,320,965.36	6.14
2	600036	招商银行	2,578,989	45,132,307.50	5.85
3	601169	北京银行	3,187,667	33,056,106.79	4.29
4	601688	华泰证券	1,448,786	27,411,031.12	3.55
5	600048	保利地产	3,039,332	26,229,435.16	3.40
6	601668	中国建筑	4,603,863	24,492,551.16	3.18
7	601009	南京银行	2,517,142	23,635,963.38	3.06
8	601288	农业银行	7,175,508	22,961,625.60	2.98
9	601939	建设银行	3,832,600	18,204,850.00	2.36
10	600999	招商证券	1,093,822	18,048,063.00	2.34
11	600519	贵州茅台	60,527	17,669,041.84	2.29
12	601601	中国太保	643,332	17,395,697.28	2.26
13	600104	上汽集团	836,134	16,965,158.86	2.20
14	601766	中国中车	1,745,587	16,007,032.79	2.08
15	600150	中国船舶	673,853	14,999,967.78	1.95
16	000166	申万宏源	1,777,669	14,950,196.29	1.94
17	601166	兴业银行	979,331	14,925,004.44	1.94
18	600019	宝钢股份	2,934,520	14,379,148.00	1.86
19	600028	中国石化	3,012,042	14,216,838.24	1.84
20	300059	东方财富	626,360	13,905,192.00	1.80



21	000538	云南白药	212,938	13,691,913.40	1.78
22	600887	伊利股份	739,906	12,334,233.02	1.60
23	601988	中国银行	3,632,126	11,659,124.46	1.51
24	601088	中国神华	810,392	11,402,215.44	1.48
25	600015	华夏银行	1,132,813	11,203,520.57	1.45
26	600837	海通证券	722,182	11,136,046.44	1.44
27	600690	青岛海尔	1,194,210	10,604,584.80	1.38
28	000100	TCL 集团	2,898,500	9,536,065.00	1.24
29	000725	京东方 A	4,126,780	9,532,861.80	1.24
30	600050	中国联通	2,407,473	9,172,472.13	1.19
31	000002	万 科 A	503,640	9,166,248.00	1.19
32	600030	中信证券	537,179	8,718,415.17	1.13
33	000858	五 粮 液	259,464	8,440,363.92	1.09
34	000776	广发证券	471,338	7,899,624.88	1.02
35	600016	民生银行	793,854	7,089,116.22	0.92
36	000001	平安银行	744,046	6,473,200.20	0.84
37	601899	紫金矿业	1,336,819	4,505,080.03	0.58
38	002415	海康威视	206,611	4,433,872.06	0.57
39	000651	格力电器	190,674	4,208,175.18	0.55
40	600583	海油工程	598,361	4,134,674.51	0.54
41	600886	国投电力	590,706	3,898,659.60	0.51
42	600739	辽宁成大	215,600	3,356,892.00	0.44
43	601901	方正证券	429,801	3,292,275.66	0.43
44	601328	交通银行	577,061	3,248,853.43	0.42
45	600000	浦发银行	178,714	2,782,576.98	0.36
46	600585	海螺水泥	184,580	2,683,793.20	0.35
47	600705	中航资本	430,000	2,528,400.00	0.33
48	601377	兴业证券	292,934	2,164,782.26	0.28
49	000333	美的集团	84,348	2,000,734.56	0.26
50	002304	洋河股份	25,718	1,849,638.56	0.24
51	600089	特变电工	201,530	1,717,035.60	0.22
52	300498	温氏股份	40,300	1,459,666.00	0.19
53	601818	光大银行	373,420	1,404,059.20	0.18
54	600900	长江电力	103,628	1,294,313.72	0.17
55	601989	中国重工	202,696	1,283,065.68	0.17
56	300104	乐视网	22,000	1,164,020.00	0.15
57	600276	恒瑞医药	26,952	1,081,044.72	0.14
58	000768	中航飞机	48,775	960,379.75	0.12
59	600518	康美药业	61,900	940,261.00	0.12

60	002024	苏宁云商	82,800	899,208.00	0.12
61	601006	大秦铁路	129,168	831,841.92	0.11
62	601390	中国中铁	116,845	814,409.65	0.11
63	000783	长江证券	69,584	807,174.40	0.10
64	601628	中国人寿	34,056	709,045.92	0.09
65	002594	比亚迪	11,200	683,312.00	0.09
66	000063	中兴通讯	46,900	672,546.00	0.09
67	600795	国电电力	219,319	642,604.67	0.08
68	002736	国信证券	37,100	639,975.00	0.08
69	601857	中国石油	88,158	637,382.34	0.08
70	600637	东方明珠	25,551	620,122.77	0.08
71	001979	招商蛇口	43,130	614,602.50	0.08
72	601211	国泰君安	34,500	613,755.00	0.08
73	601186	中国铁建	61,168	609,233.28	0.08
74	000625	长安汽车	43,621	596,299.07	0.08
75	601985	中国核电	87,300	596,259.00	0.08
76	600111	北方稀土	43,599	580,302.69	0.08
77	600703	三安光电	28,800	575,136.00	0.07
78	600893	中航动力	16,200	561,330.00	0.07
79	600011	华能国际	74,150	557,608.00	0.07
80	601336	新华保险	13,800	557,520.00	0.07
81	601099	太平洋	90,070	552,129.10	0.07
82	600109	国金证券	39,300	529,764.00	0.07
83	600010	包钢股份	181,200	518,232.00	0.07
84	600029	南方航空	71,200	502,672.00	0.07
85	601727	上海电气	64,000	483,840.00	0.06
86	600352	浙江龙盛	55,200	475,824.00	0.06
87	300027	华谊兄弟	35,139	475,782.06	0.06
88	600804	鹏博士	24,510	446,817.30	0.06
89	600118	中国卫星	13,000	436,800.00	0.06
90	600958	东方证券	24,700	415,207.00	0.05
91	000728	国元证券	24,663	412,365.36	0.05
92	601998	中信银行	71,938	407,888.46	0.05
93	601669	中国电建	70,800	404,268.00	0.05
94	600018	上港集团	75,852	386,845.20	0.05
95	601800	中国交建	35,540	374,236.20	0.05
96	600023	浙能电力	68,900	350,701.00	0.05
97	601106	中国一重	60,900	317,289.00	0.04

## 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	1,273,685	18,825,064.30	2.44
2	002400	省广股份	506,342	7,154,612.46	0.93
3	300224	正海磁材	247,500	5,610,825.00	0.73
4	000970	中科三环	380,100	5,515,251.00	0.72
5	002234	民和股份	153,500	4,514,435.00	0.59
6	002458	益生股份	102,850	4,505,858.50	0.58
7	000829	天音控股	279,600	3,732,660.00	0.48
8	000881	大连国际	144,260	3,183,818.20	0.41
9	601966	玲珑轮胎	6,026	78,217.48	0.01
10	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
11	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
12	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
13	601611	中国核建	2,016	42,174.72	0.01
14	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
15	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
16	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
17	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
18	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
19	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	47,349,046.26	5.28
2	601211	国泰君安	37,398,480.21	4.17
3	601318	中国平安	33,585,677.60	3.74
4	300059	东方财富	33,089,224.91	3.69
5	601818	光大银行	30,996,617.61	3.45
6	601169	北京银行	28,996,082.30	3.23
7	000858	五粮液	28,628,524.72	3.19
8	000001	平安银行	27,867,577.42	3.10
9	601939	建设银行	27,620,545.82	3.08

10	601688	华泰证券	26,201,822.90	2.92
11	000100	TCL 集团	24,669,923.57	2.75
12	600030	中信证券	24,202,581.20	2.70
13	600150	中国船舶	23,729,464.97	2.64
14	600887	伊利股份	23,407,434.11	2.61
15	600886	国投电力	23,187,624.31	2.58
16	601009	南京银行	22,898,512.95	2.55
17	000776	广发证券	22,780,902.20	2.54
18	600637	东方明珠	22,251,949.16	2.48
19	600019	宝钢股份	21,123,940.43	2.35
20	601766	中国中车	20,693,368.90	2.31
21	601988	中国银行	20,384,045.70	2.27
22	600999	招商证券	19,964,699.92	2.22
23	600015	华夏银行	19,171,164.57	2.14
24	601288	农业银行	18,922,287.00	2.11
25	601601	中国太保	18,917,716.60	2.11
26	002142	宁波银行	18,733,155.14	2.09
27	600690	青岛海尔	18,636,245.00	2.08
28	600104	上汽集团	18,402,201.13	2.05
29	600048	保利地产	18,377,300.76	2.05
30	000166	申万宏源	18,034,763.97	2.01

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	57,559,845.83	6.41
2	600030	中信证券	40,272,675.32	4.49
3	601211	国泰君安	39,239,451.99	4.37
4	601288	农业银行	34,132,717.37	3.80
5	601818	光大银行	29,390,914.86	3.27
6	600016	民生银行	29,081,451.20	3.24
7	601318	中国平安	26,778,057.94	2.98
8	000001	平安银行	26,387,331.53	2.94
9	600015	华夏银行	26,185,842.17	2.92
10	600886	国投电力	25,495,558.00	2.84

11	600637	东方明珠	24,435,113.84	2.72
12	601939	建设银行	23,576,093.35	2.63
13	300059	东方财富	23,380,192.80	2.60
14	000858	五粮液	22,766,579.39	2.54
15	600887	伊利股份	22,181,472.63	2.47
16	000333	美的集团	21,807,948.95	2.43
17	000776	广发证券	21,063,200.35	2.35
18	600011	华能国际	20,788,567.23	2.32
19	000100	TCL 集团	19,622,955.50	2.19
20	600000	浦发银行	17,808,416.86	1.98

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,111,624,617.45
卖出股票收入（成交）总额	1,121,612,079.67

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,994,000.00	3.89
	其中：政策性金融债	29,994,000.00	3.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,994,000.00	3.89

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	160401	16 农发 01	300,000	29,994,000.00	3.89

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

###### (1) 华泰证券

2015年9月10日，华泰证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]72号），拟对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得18,235,275元，并处以54,705,825元罚款。

###### (2) 农业银行

2016年1月22日，中国农业银行股份有限公司北京分行票据买入返售业务发生重大风险事件，

经核查,涉及风险金额为39.15亿元。公安机关已立案侦查。中国农业银行股份有限公司公告表示积极配合侦办工作,加强与相关机构沟通协调,最大限度保证资金安全。

本基金依照法律法规及基金合同的约定,采取指数化投资策略,紧密跟踪标的指数。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	132,082.70
2	应收证券清算款	1,225,655.10
3	应收股利	-
4	应收利息	360,589.10
5	应收申购款	5,589.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,723,916.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
60,923	13,370.85	722,411.53	0.09%	813,869,877.53	99.91%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	宋適午	383,500.00	1.98%
2	方燕秋	336,807.00	1.74%
3	赵凡	329,417.00	1.70%
4	范萍	200,000.00	1.03%
5	赵立泉	200,000.00	1.03%
6	仇培红	188,100.00	0.97%
7	麦玉璧	164,500.00	0.85%
8	王翔	159,800.00	0.82%
9	杨泽群	150,078.00	0.77%
10	陈红	150,000.00	0.77%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,544.44	0.0061%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日 (2005 年 5 月 12 日) 基金份额总额	513,527,198.43
本报告期期初基金份额总额	825,119,992.48
本报告期基金总申购份额	51,022,313.71
减:本报告期基金总赎回份额	61,550,017.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	814,592,289.06

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内, 基金管理人无重大人事变更。

## 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动



本报告期内，专门基金托管部门无重大人事变更。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
新时代证券	1	1,566,527,815.03	70.19%	1,458,905.22	70.62%	-
银河证券	1	636,889,449.05	28.54%	580,397.98	28.10%	-
光大证券	1	28,382,553.59	1.27%	26,432.91	1.28%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 财力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；

- (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求;
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务;
- (6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务, 包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专门研究报告。

2. 选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤:

- (1) 券商服务评价;
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商;
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准;
- (4) 签约。在获得批准后, 按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3. 本报告期内, 交易单元无变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-4
2	融通基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-6
3	融通基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-7
4	关于深圳富济财富管理有限公司开通融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-18
5	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加浙江同花顺基金销售有限公司基金申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-2-19
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-2-25

7	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-7
8	融通基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-12
9	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券有限责任公司基金申购费率（含定期定额投资）优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-21
10	融通关于旗下部分开放式基金新增代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-24
11	关于旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-31
12	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-4-20
13	关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-4-25
14	融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-9
15	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增突丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-13
16	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-20
17	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-24
18	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-17
19	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-24
20	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-30

## § 11 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通巨潮 100 指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通巨潮 100 指数证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)《融通巨潮 100 指数证券投资基金上市交易公告书》

(六)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(七)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(八)基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

存放地点:基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所

查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查询。